

DAFTAR PUSTAKA

- Amanah, F & Subekti, R. (2016). *Analisis Tracking Error untuk Mengukur Kinerja Portofolio Model Black Litterman*. Skripsi. Yogyakarta : UNY.
- Anton, H. (1994). *Elementary Linear Algebra Seventh Edition*. New York: John Wiley & Sons, INC.
- Azzalini, A. (2005). *A Very Brief Introduction to Skew Normal Distribution*. Diakses dari <http://azzalini.stat.unipd.it/SN> pada tanggal 01 Maret 2017 pukul 09.27 WIB.
- Blasi, F.S. (2009). *Black Litterman in Skew Normal Distribution Market*. Journal of Financial. 10. 1-6.
- Engelhardt, L. J. (1992). *Introduction to Probability and Mathematical Statistics*. California: Duxbury Press.
- Haerunnisa, S. & Subekti, R. (2016). *Kinerja Model Black Litterman dengan Strategi Diversifikasi Naive dan Minimum Variance dalam Analisis Portofolio Saham Syariah*. Skripsi. Yogyakarta : UNY.
- Halim, A. (2005). *Analisis Investasi Edisi 2*. Jakarta: Salemba Empat.
- Hanke J.E., & Winchern. (2005). *Business Forecasting* . New Jersey: Pearson Prentice Hall.
- Hartono, J. (2014 (a)). *Teori dan Praktik Portofolio dengan Excel*. Jakarta: Salemba Empat.
- Hartono, J. (2014 (b)). *Teori Portofolio dan Analisis Investasi Edisi Kesembilan*. Yogyakarta: BPFE Yogyakarta.
- Howard Anton, C. R. (2004). *Aljabar Linear Elementer versi Aplikasi Edisi Kedelapan*. (A. Safitri, Penyunt., & I. H. Refina Indriasari, Penerj.) Jakarta: Erlangga.

- Husnan, S. (2005). *Dasar-Dasar Teori Portofolio dan Analisis Sekuritas*. Yogyakarta: Unit Penerbit dan Percetakan AMP YKPN.
- Idzorek, T. M. (2005). *A Step-by-Step Guide to The Black Litterman Model : Incorporating user-specified confidence levels*. *Journal of Elsevier Finance*.
- Litterman, G. H. (1999). *The Intuition Behind Black Litterman Model Portofolio Composition*. *Investment Management Research*. Goldman: Sachs & Company.
- LQ-45. Saham OK. Diakses dari <http://www.sahamok.com/bei/lq-45/> pada tanggal 30 Januari 2017. Pukul 21. 17 WIB.
- Markowitz, H. (1952). *Portofolio Selection*. *Journal of Finance* Vol. 7 No. 1, 77-91
- Murray R. Spiegel, J. (2004). *Probabilitas dan Statistik Edisi Kedua*. Jakarta: Erlangga.
- Rosadi, D. (2012). *Diktat Kuliah Manajemen Risiko Kuantitatif*. Yogyakarta.
- Rossler, H. L. (1972). *Introduction to Probabily and Statistics Fifth Edition*. University of California: Davis.
- Scowcroft, S. S. (2000). *A Demystification of the B-L Model : Managing Quantitative and Traditional Portofolio Construction*. *Journal of Asset Management*, 138-150.
- Setiawan, R.D, (2011). *Distribusi Skew Normal*. Skripsi. Depok : UI.
- Sharpe, W. F. (1966). *Mutual Fund Performance*. *The Journal of Business*, Vol. 39 No. 1, 119-138.
- Spiegel, M. & Sthepens, L. (2004). *Schaum Outlines Statistik*. Edisi Ketiga. Jakarta :Erlangga
- Subekti, R. (2008). *Aplikasi Model Black Litterman dengan Pendekatan Bayes*. *Seminar Nasional Matematika FMIPA UNY*, (hal. 1-12). Yogyakarta.

- Subekti, R. (2009). *Keunikan Model Black Litterman dalam Pembentukan Portofolio. Prosiding Seminar Nasional Penelitian, Pendidikan dan Penerapan MIPA, FMIPA UNY*, (hal. 147-150). Yogyakarta.
- Tandelilin, E. (2001). *Analisis Investasi dan Manajemen Portofolio*. Yogyakarta: BPPE-Yogyakarta.
- Tandelilin, E. (2010). *Portofolio dan Investasi Teori dan Aplikasi*. Edisi Pertama. Yogyakarta : Kanisius.
- Winchern, J. R. (2007). *Applied Multivariate Statistical Analysis*. New Jersey: Pearson Education, Inc.
- Yang, X. (2014). *Some Extensions of the Black Litterman Model* (23-30). Rio de Janeiro : IMPA.
- _____. Kamus Versi Online Kamus Besar Bahasa Indonesia. Diakses dari <http://kbbi.web.id/pasar> pada tanggal 30 Januari 2017. Pukul 21.25 WIB.